

**华夏沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
2013 年半年度报告摘要**

**2013 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十六日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金简称       | 华夏沪深300ETF联接       |
| 基金主代码      | 000051             |
| 交易代码       | 000051             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2009年7月10日         |
| 基金管理人      | 华夏基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 31,350,919,797.02份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 510330                  |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2012 年 12 月 25 日        |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                 |
| 上市日期         | 2013 年 1 月 16 日         |
| 基金管理人名称      | 华夏基金管理有限公司              |
| 基金托管人名称      | 中国工商银行股份有限公司            |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 采用指数化投资方式, 追求对标的指数的有效跟踪, 获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。                                                                                                                                      |
| 投资策略   | 本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF 的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况, 本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析, 对投资组合进行监控和调整, 密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利, 以增强基金收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1\%$ (指年收益率, 评价时应按期间折算)。                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。                                                                                                                                                   |

#### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                    |
| 投资策略   | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。                                   |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。                                                         |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                | 基金托管人               |
|-------------|------|----------------------|---------------------|
| 名称          |      | 华夏基金管理有限公司           | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 崔雁巍                  | 赵会军                 |
|             | 联系电话 | 400-818-6666         | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-818-6666         | 95588               |
| 传真          |      | 010-63136700         | 010-66105798        |

### 2.4 信息披露方式

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所   |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -359,482,926.50                      |
| 本期利润          | -2,230,035,301.95                    |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0811                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -10.95%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2013 年 6 月 30 日）                |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3413                              |
| 期末基金资产净值      | 20,651,680,920.70                    |
| 期末基金份额净值      | 0.659                                |

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -14.08%  | 1.78%       | -14.71%    | 1.77%         | 0.63%  | 0.01%  |
| 过去三个月      | -10.10%  | 1.37%       | -10.96%    | 1.38%         | 0.86%  | -0.01% |
| 过去六个月      | -10.95%  | 1.43%       | -11.64%    | 1.42%         | 0.69%  | 0.01%  |
| 过去一年       | -8.22%   | 1.31%       | -9.07%     | 1.30%         | 0.85%  | 0.01%  |
| 过去三年       | -9.35%   | 1.31%       | -10.43%    | 1.30%         | 1.08%  | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | -34.10%  | 1.38%       | -29.47%    | 1.44%         | -4.63% | -0.06% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2009 年 7 月 10 日至 2013 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至 2013 年 6 月 30 日，华夏基金管理的境内 ETF 产品规模超过 440 亿元，是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一。在 ETF 基金管理方面，华夏基金积累了丰富的经验，目前旗下管理 9 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏能源 ETF、华夏材料 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF 和华夏恒生 ETF，初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

2013 年上半年，在《证券时报》主办的“2012 年度中国基金业明星基金奖”的评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖；在《上海证券报》主办的第十届中国“金基金”奖的评选中，华夏基金荣获“金基金十年·卓越公司奖”；在《中国证券报》主办的“第十届中国基金业金牛奖”的评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖；在晨星（中国）举办的“晨星（中国）2013 年度基金奖”评选中，华夏回报混合荣获“混合型基金奖”。

在客户服务方面，上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高服务质量：（1）升级了货币基金的快速赎回业务：扩充了支持银行卡的范围，延长了业务办理时间；（2）推出了货币基金“还贷款”及信用卡还款业务，推出了直销网上交易“跨行随意取”业务，开通了支付宝交易渠道，方便投资者进行现金管理；（3）直销网上交易新增了中国建设银行储蓄卡的“快易付”功能，并增加多家银行卡的电子交易业务，提高投资者的交易效率；（4）开通了华夏基金微信公众平台，满足投资者服务渠道多样化的需求。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|     |                    | 任职日期       | 离任日期 | 年限   |                                                                                    |
|-----|--------------------|------------|------|------|------------------------------------------------------------------------------------|
| 方军  | 本基金的基金经理、数量投资部副总经理 | 2009-07-10 | -    | 14 年 | 硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。 |
| 张弘弢 | 本基金的基金经理、数量投资部副总经理 | 2009-07-10 | -    | 13 年 | 硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。                                             |

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1\%$ （指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金）的份额，从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

2013 年上半年，国际方面，美国经济呈现较明显的复苏态势，货币政策维持宽松，然而 2 季度美联储即将退出量化宽松政策的预期导致市场出现较大波动；欧洲经济仍然相对疲弱；日本继续采取宽松货币政策，日元出现较为明显的贬值，对日本短期经济复苏产生一定效果但长期尚需观察。国内方面，经济运行总体平稳，但投资、消费、出口等数据在 2 季度出现了一定程度放缓；通货膨胀仍然维持在较低水平；社会融资总额同比仍保持较快增长，但 6 月份受外汇占款下降等因素影响，市场资金面趋紧，6 月中下旬短期利率大幅飙升。

上半年，A 股证券市场总体呈震荡走势。春节前，在投资者对经济复苏、流动性宽松等的较强预期下，市场出现了上涨，沪深 300 指数期间涨幅接近 10%。随后在经济基本面不及预期，流动性逐渐紧张背景下，市场总体震荡下跌。报告期内，沪深 300 指数下跌 12.78%。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.659 元，本报告期份额净值增长率为-10.95%，同期业绩比较基准增长率为-11.64%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.69%。本基金与业绩比较基准产生偏离的主要原因为目标 ETF 偏离、成份股分红、日常运作费用、大额申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，国内经济可能进一步放缓，通货膨胀维持低位，宏



观政策可能会一定程度微调，但大幅超预期调整的可能性不大。

基于上述判断，市场方面，沪深 300 指数以震荡走势为主。如果出现经济基本面或者宏观经济政策的超预期，沪深 300 指数可能有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2013 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                        |                          |
| 银行存款       |     | 410,347,217.30         | 355,271,755.02           |
| 结算备付金      |     | 7,238,458.02           | 9,818,489.58             |
| 存出保证金      |     | 7,998,794.47           | 1,000,000.00             |
| 交易性金融资产    |     | 20,186,629,203.67      | 20,216,603,687.86        |
| 其中：股票投资    |     | 2,689,363,364.89       | 3,611,710,126.96         |
| 基金投资       |     | 16,779,303,838.78      | 15,921,962,804.58        |
| 债券投资       |     | 717,962,000.00         | 682,930,756.32           |
| 资产支持证券投资   |     | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     |     | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   |     | -                      | -                        |
| 应收证券清算款    |     | 7,227,312.31           | 1,478,841.84             |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 应收利息            |            | 12,008,549.97                  | 14,713,006.17                    |
| 应收股利            |            | 4,576,592.78                   | -                                |
| 应收申购款           |            | 184,925,093.62                 | 13,213,727.28                    |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | 13,699.00                      | -                                |
| 资产总计            |            | 20,820,964,921.14              | 20,612,099,507.75                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2013 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2012 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 50,542,983.44                  | -                                |
| 应付赎回款           |            | 114,962,043.75                 | 72,024,101.37                    |
| 应付管理人报酬         |            | 908,677.20                     | 7,289,768.90                     |
| 应付托管费           |            | 181,735.44                     | 1,457,953.76                     |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          |            | 1,369,157.26                   | 1,103,587.15                     |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            |            | 1,319,403.35                   | 1,296,944.30                     |
| 负债合计            |            | 169,284,000.44                 | 83,172,355.48                    |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            |            | 31,350,919,797.02              | 27,756,194,055.50                |
| 未分配利润           |            | -10,699,238,876.32             | -7,227,266,903.23                |
| 所有者权益合计         |            | 20,651,680,920.70              | 20,528,927,152.27                |
| 负债和所有者权益总计      |            | 20,820,964,921.14              | 20,612,099,507.75                |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.659 元，基金份额总额 31,350,919,797.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |     | -2,220,108,361.33                        | 1,178,964,896.56                              |
| 1.利息收入                     |     | 11,212,841.96                            | 12,424,001.17                                 |
| 其中：存款利息收入                  |     | 1,351,829.47                             | 932,892.97                                    |
| 债券利息收入                     |     | 9,861,012.49                             | 11,491,108.20                                 |
| 资产支持证券利息收入                 |     | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                 |     | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                     |     | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |     | -362,538,746.46                          | -541,573,065.10                               |
| 其中：股票投资收益                  |     | -415,382,992.14                          | -755,532,279.72                               |
| 基金投资收益                     |     | 34,103,004.55                            | -                                             |
| 债券投资收益                     |     | 1,605,008.67                             | 4,179,642.20                                  |
| 资产支持证券投资收益                 |     | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                     |     | -                                        | -                                             |
| 股利收益                       |     | 17,136,232.46                            | 209,779,572.42                                |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |     | -1,870,552,375.45                        | 1,707,055,786.01                              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |     | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |     | 1,769,918.62                             | 1,058,174.48                                  |
| <b>减：二、费用</b>              |     | 9,926,940.62                             | 60,756,563.44                                 |
| 1.管理人报酬                    |     | 5,865,159.11                             | 47,499,309.87                                 |
| 2.托管费                      |     | 1,173,031.81                             | 9,499,861.96                                  |
| 3.销售服务费                    |     | -                                        | -                                             |
| 4.交易费用                     |     | 2,396,013.67                             | 3,509,874.42                                  |
| 5.利息支出                     |     | 283,182.28                               | 44,587.83                                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |     | 283,182.28                               | 44,587.83                                     |
| 6.其他费用                     |     | 209,553.75                               | 202,929.36                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |     | -2,230,035,301.95                        | 1,118,208,333.12                              |
| 减：所得税费用                    |     | -                                        | -                                             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |     | -2,230,035,301.95                        | 1,118,208,333.12                              |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日      |                    |                   |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润              | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 27,756,194,055.50                          | -7,227,266,903.23  | 20,528,927,152.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -2,230,035,301.95  | -2,230,035,301.95 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 3,594,725,741.52                           | -1,241,936,671.14  | 2,352,789,070.38  |
| 其中：1.基金申购款                             | 7,691,411,565.87                           | -2,261,822,386.21  | 5,429,589,179.66  |
| 2.基金赎回款                                | -4,096,685,824.35                          | 1,019,885,715.07   | -3,076,800,109.28 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -                  | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 31,350,919,797.02                          | -10,699,238,876.32 | 20,651,680,920.70 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |                    |                   |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润              | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 25,970,707,526.21                          | -8,415,104,647.07  | 17,555,602,879.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 1,118,208,333.12   | 1,118,208,333.12  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -378,254,320.87                            | 86,385,375.77      | -291,868,945.10   |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,357,042,660.91                           | -626,896,481.99    | 1,730,146,178.92  |
| 2.基金赎回款                                | -2,735,296,981.78                          | 713,281,857.76     | -2,022,015,124.02 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -                  | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 25,592,453,205.34                          | -7,210,510,938.18  | 18,381,942,267.16 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王东明
崔雁巍
崔雁巍  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 6.4.3 关联方关系

###### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

###### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                   | 与本基金的关系               |
|-------------------------|-----------------------|
| 华夏基金管理有限公司              | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")  | 基金托管人、基金销售机构          |
| 华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 | 本基金是该基金的联接基金          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.4.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,865,159.11                             | 47,499,309.87                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,342,497.81                            | 12,483,620.48                                 |

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=(前一日的基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.5% / 当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,173,031.81                             | 9,499,861.96                                  |

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=(前一日的基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.1% / 当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债

券(含回购)交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |            |
|--------|------------------------------------------|--------------|-----------------------------------------------|------------|
|        | 期末余额                                     | 当期利息收入       | 期末余额                                          | 当期利息收入     |
| 中国工商银行 | 410,347,217.30                           | 1,246,103.16 | 370,512,316.01                                | 898,861.54 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

##### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

截至 2013 年 6 月 30 日止，本基金持有 7,525,363,878 份目标 ETF 基金份额（2012 年 12 月 31 日：15,417,800,721 份），占其总份额的比例为 88.80%（2012 年 12 月 31 日：96.24%）。

#### 6.4.5 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.5.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |           |       |        |           |               |               |    |
|---------------------|------|------------|------------|-----------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型    | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股）  | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 000562              | 宏源证券 | 2012-06-28 | 2013-07-04 | 非公开发行流通受限 | 13.22 | 8.79   | 4,000,000 | 52,880,000.00 | 35,160,000.00 | -  |
| 000562              | 宏源证券 | -          | 2013-07-04 | 非公开       | -     | 8.79   | 4,000,000 | -             | 35,160,000.00 | -  |



|  |  |  |  |      |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|------|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 发行转增 |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|------|--|--|--|--|--|--|

注：本基金持有的非公开发行股票宏源证券，于 2013 年 6 月 19 日实施 2012 年度利润分配、转增股本方案，向全体股东按每 10 股派送现金人民币 6.00 元（含税），同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股，本基金新增 4,000,000 股。

#### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因           | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|----------------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 000999 | 华润三九 | 2013-06-03 | 筹划重大资产重组事项     | 26.55  | 2013-08-19 | 26.51  | 67,771  | 1,987,522.65 | 1,799,320.05 | -  |
| 600547 | 山东黄金 | 2013-04-03 | 筹划重大资产重组事项     | 32.13  | 2013-07-01 | 28.77  | 36,554  | 1,296,440.67 | 1,174,480.02 | -  |
| 600598 | 北大荒  | 2013-05-27 | 筹划重大资产重组事项     | 8.35   | 2013-07-19 | 8.35   | 117,300 | 979,527.85   | 979,455.00   | -  |
| 601918 | 国投新集 | 2013-05-16 | 控股股东筹划重大资产重组事项 | 7.55   | 2013-08-23 | 5.05   | 9,711   | 85,666.69    | 73,318.05    | -  |
| 601989 | 中国重工 | 2013-05-17 | 控股股东筹划重大事项     | 4.52   | -          | -      | 138,020 | 736,680.66   | 623,850.40   | -  |

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

### 6.4.6.2 各层级金融工具公允价值

截至 2013 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为 19,695,647,883.62 元，第二层级的余额为 490,981,320.05 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2012 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 19,753,609,665.56 元，第二层级的余额为 462,994,022.30 元，第三层级的余额为 0 元。）

### 6.4.6.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层级或第三层级转入第一层级。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层级转入第一层级。

### 6.4.6.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 2,689,363,364.89  | 12.92         |
|    | 其中：股票             | 2,689,363,364.89  | 12.92         |
| 2  | 基金投资              | 16,779,303,838.78 | 80.59         |
| 3  | 固定收益投资            | 717,962,000.00    | 3.45          |
|    | 其中：债券             | 717,962,000.00    | 3.45          |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                 | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                 | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 417,585,675.32    | 2.01          |
| 7  | 其他各项资产            | 216,750,042.15    | 1.04          |
| 8  | 合计                | 20,820,964,921.14 | 100.00        |

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称        | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------------|------|--------|------------|-------------------|---------------|
| 1  | 华夏沪深 300ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 华夏基金管理有限公司 | 16,779,303,838.78 | 81.25         |

## 7.3 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 13,832,998.02    | 0.07          |
| B  | 采矿业              | 178,921,604.40   | 0.87          |
| C  | 制造业              | 1,013,884,247.20 | 4.91          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 136,962,995.20   | 0.66          |
| E  | 建筑业              | 124,945,798.00   | 0.61          |
| F  | 批发和零售业           | 83,185,994.36    | 0.40          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 60,905,789.60    | 0.29          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 58,705,452.61    | 0.28          |
| J  | 金融业              | 808,367,999.32   | 3.91          |
| K  | 房地产业             | 157,022,322.12   | 0.76          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 12,240,157.87    | 0.06          |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -                | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,747,754.12    | 0.08  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -                | -     |
| P | 教育            | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 4,855,452.73     | 0.02  |
| S | 综合            | 19,784,799.34    | 0.10  |
|   | 合计            | 2,689,363,364.89 | 13.02 |

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 8,899,070  | 103,229,212.00 | 0.50         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 11,584,800 | 99,281,736.00  | 0.48         |
| 3  | 000562 | 宏源证券 | 8,200,000  | 72,078,000.00  | 0.35         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 1,964,147  | 68,273,749.72  | 0.33         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 4,259,044  | 62,906,079.88  | 0.30         |
| 6  | 000002 | 万科A  | 5,950,800  | 58,615,380.00  | 0.28         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 230,402    | 44,322,432.74  | 0.21         |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 1,644,342  | 41,207,210.52  | 0.20         |
| 9  | 600000 | 浦发银行 | 4,463,198  | 36,955,279.44  | 0.18         |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 2,066,824  | 35,011,998.56  | 0.17         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 104,497,347.89 | 0.51           |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 102,570,902.68 | 0.50           |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 68,605,334.05  | 0.33           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 67,459,610.75  | 0.33           |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 51,777,172.22  | 0.25           |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 49,406,391.92  | 0.24           |
| 7  | 601328 | 交通银行 | 45,957,107.84  | 0.22           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 8  | 000002 | 万 科 A | 45,930,351.72 | 0.22 |
| 9  | 601088 | 中国神华  | 36,274,555.80 | 0.18 |
| 10 | 600837 | 海通证券  | 36,226,588.11 | 0.18 |
| 11 | 601818 | 光大银行  | 30,215,586.93 | 0.15 |
| 12 | 601006 | 大秦铁路  | 29,638,262.60 | 0.14 |
| 13 | 601601 | 中国太保  | 28,766,991.73 | 0.14 |
| 14 | 601668 | 中国建筑  | 28,661,257.84 | 0.14 |
| 15 | 000651 | 格力电器  | 28,062,491.16 | 0.14 |
| 16 | 600048 | 保利地产  | 26,686,159.43 | 0.13 |
| 17 | 600104 | 上汽集团  | 26,424,462.22 | 0.13 |
| 18 | 601336 | 新华保险  | 26,231,481.12 | 0.13 |
| 19 | 600111 | 包钢稀土  | 22,650,670.30 | 0.11 |
| 20 | 601991 | 大唐发电  | 22,567,656.61 | 0.11 |

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A  | 66,070,394.38 | 0.32           |
| 2  | 600887 | 伊利股份   | 41,085,554.87 | 0.20           |
| 3  | 000651 | 格力电器   | 34,455,641.19 | 0.17           |
| 4  | 000001 | 平安银行   | 29,366,252.80 | 0.14           |
| 5  | 000776 | 广发证券   | 27,944,132.96 | 0.14           |
| 6  | 000858 | 五 粮 液  | 27,332,661.11 | 0.13           |
| 7  | 601166 | 兴业银行   | 22,544,969.62 | 0.11           |
| 8  | 600837 | 海通证券   | 21,954,378.46 | 0.11           |
| 9  | 000157 | 中联重科   | 21,487,451.81 | 0.10           |
| 10 | 600000 | 浦发银行   | 20,260,623.97 | 0.10           |
| 11 | 600016 | 民生银行   | 19,641,927.09 | 0.10           |
| 12 | 000538 | 云南白药   | 19,601,770.73 | 0.10           |
| 13 | 002024 | 苏宁云商   | 16,736,594.64 | 0.08           |
| 14 | 600036 | 招商银行   | 14,398,368.77 | 0.07           |
| 15 | 000983 | 西山煤电   | 13,752,812.96 | 0.07           |
| 16 | 000100 | TCL 集团 | 13,735,238.52 | 0.07           |
| 17 | 000069 | 华侨城 A  | 13,241,781.83 | 0.06           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 000562 | 宏源证券 | 13,136,490.54 | 0.06 |
| 19 | 000895 | 双汇发展 | 12,908,120.73 | 0.06 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 12,695,598.95 | 0.06 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,693,366,313.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,344,649,757.30 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 299,100,000.00 | 1.45         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 418,862,000.00 | 2.03         |
|    | 其中：政策性金融债 | 418,862,000.00 | 2.03         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | -              | -            |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 717,962,000.00 | 3.48         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 019302 | 13 国债 02 | 3,000,000 | 299,100,000.00 | 1.45         |
| 2  | 130201 | 13 国开 01 | 2,000,000 | 198,900,000.00 | 0.96         |
| 3  | 120228 | 12 国开 28 | 1,000,000 | 99,950,000.00  | 0.48         |
| 4  | 130214 | 13 国开 14 | 700,000   | 70,112,000.00  | 0.34         |
| 5  | 080307 | 08 进出 07 | 500,000   | 49,900,000.00  | 0.24         |

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资  
 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,998,794.47   |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,227,312.31   |
| 3  | 应收股利    | 4,576,592.78   |
| 4  | 应收利息    | 12,008,549.97  |
| 5  | 应收申购款   | 184,925,093.62 |
| 6  | 其他应收款   | 13,699.00      |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 216,750,042.15 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明      |
|----|--------|------|---------------|---------------|---------------|
| 1  | 000562 | 宏源证券 | 70,320,000.00 | 0.34          | 非公开发行<br>流通受限 |

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构            |        |                   |        |
|-----------|-----------|------------------|--------|-------------------|--------|
|           |           | 机构投资者            |        | 个人投资者             |        |
|           |           | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额              | 占总份额比例 |
| 556,544   | 56,331.43 | 7,761,675,060.85 | 24.76% | 23,589,244,736.17 | 75.24% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份)    | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 10,646,166.26 | 0.03%    |

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；本基金的基金经理未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                             |                   |
|-----------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2009年7月10日) 基金份额总额 | 24,771,957,170.09 |
| 本报告期期初基金份额总额                | 27,756,194,055.50 |
| 本报告期基金总申购份额                 | 7,691,411,565.87  |
| 减：本报告期基金总赎回份额               | 4,096,685,824.35  |
| 本报告期基金拆分变动份额                | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                | 31,350,919,797.02 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2013 年 5 月 25 日发布公告，刘文动先生不再担任华夏基金



管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 海通证券 | 1      | 2,580,411,974.82 | 63.91%       | 284,868.85 | 67.01%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 1,457,134,492.66 | 36.09%       | 140,243.43 | 32.99%     | -  |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了广发证券、中投证券和中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 回购交易           |              | 基金交易             |              |
|------|----------------|--------------|----------------|--------------|------------------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期基金成交总额的比例 |
| 海通证券 | 134,563,697.60 | 91.38%       | 768,500,000.00 | 100.00%      | 1,452,636,900.08 | 100.00%      |
| 光大证券 | 12,700,566.39  | 8.62%        | -              | -            | -                | -            |

华夏基金管理有限公司

二〇一三年八月二十六日